

# 华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 79号

## 2024年第2季度报告

### 重要信息提示：

- 理财非存款，产品有风险，投资须谨慎。理财产品过往业绩不代表其未来表现，不等于理财产品实际收益。
- 华夏理财有限责任公司保留对所有文字说明的最终解释权。

产品管理人：华夏理财有限责任公司

产品托管人：华夏银行股份有限公司

报 告 期：2024年4月1日至2024年6月30日

## 第一章 基本信息

产品名称	华夏理财固定收益增强型封闭式理财产品 79 号
理财产品代码	22131079
产品登记编码	Z7003922000104
产品募集方式	公募
产品运作模式	封闭式
产品投资性质	固定收益类
投资及收益币种	人民币
产品风险评级	PR2 级（中低风险）
杠杆水平	112.57%
产品起始日期	2022-12-22
产品终止日期	2025-12-16

## 第二章 净值、存续规模及收益表现

### 2.1 净值和存续规模

估值日期	份额净值 (元)	份额总数(份)	累计净值 (元)	资产净值(元)
2024-06-30	1.0851	36,299,347.00	1.0851	39,389,364.87

### 2.2 净值增长率

	起始和截止时间	净值增长率
报告期间	2024年3月31日-2024年6月30日	1.17%
成立以来	2022年12月22日-2024年6月30日	8.51%
2023年	2023年全年	5.71%
2022年	2022年12月22日-2022年12月31日	0.22%

注：净值增长率=(期末累计净值-期初累计净值)/期初份额净值\*100%；因投资者赎回可能导致在某个时期部分份额为0，该情形下净值增长率的所属区间不连续；年末份额为0时，该年度净值增长率为空；理财产品过往业绩不代表其未来表现，不等于理财产品实际收益，投资须谨慎。

## 第三章 资产持仓

### 3.1 期末产品资产持仓情况

序号	资产类别	穿透前占总资产比例	穿透后占总资产比例
1	现金及银行存款	3.53%	3.39%
2	同业存单	0.00%	0.00%
3	拆放同业及债券买入返售	0.00%	0.32%
4	债券	0.00%	62.45%
5	非标准化债权类资产	37.66%	33.84%
6	权益类投资	0.00%	0.00%
7	金融衍生品	0.00%	0.00%
8	代客境外理财投资 QDII	0.00%	0.00%
9	商品类资产	0.00%	0.00%
10	另类资产	0.00%	0.00%
11	公募基金	0.00%	0.00%
12	私募基金	0.00%	0.00%
13	资产管理产品	58.81%	0.00%
14	委外投资——协议方式	0.00%	0.00%

注：由于计算中四舍五入的原因，占总资产的比例可能存在尾差；“权益类投资”类别中包含优先股。

### 3.2 期末产品持有的前十项资产

序号	资产名称	资产类别	持有金额 (元)	占总资产 的比例
1	中信信托.盐城市交通投资建设控股集团.华信 22	非标准化债权类资产	15,004,702.95	33.84%
2	存款及清算款等现金类资产	现金及银行存款	1,503,265.10	3.39%
3	21 云铁 01	债券	781,666.20	1.76%
4	19 信投 03	债券	723,126.45	1.63%
5	21 孝感 01	债券	715,788.33	1.61%
6	22 建发集 MTN002	债券	589,431.37	1.33%
7	22 信地 03	债券	559,040.82	1.26%
8	21 信地 03	债券	527,450.98	1.19%
9	22 武新城	债券	447,227.63	1.01%
10	22 信地 01	债券	426,760.49	0.96%

### 3.3 期末产品持有的非标准化债权类资产

序号	融资客户	项目名称	交易结构	收益率(%)	剩余期限(天)	风险状况
1	盐城市交通投资建设控股集团有限公司	中信信托.盐城市交通投资建设控股集团有限公司.华信 22	信托贷款	5.0140	425	正常

### 3.4 报告期内关联交易情况

#### 3.4.1 报告期内投资关联方发行的证券的情况

关联方名称	证券代码	证券名称	投资规模（元）
-	-	-	-

#### 3.4.2 报告期内投资关联方承销的证券的情况

关联方名称	证券代码	证券名称	投资规模（元）
-	-	-	-

#### 3.4.3 报告期内其他关联交易

关联方名称	资产代码	资产名称	交易类型	投资规模（元）
-	-	-	-	-

## 第四章 收益分配情况

除权日期	每万份理财份额分红数（元）
-	-



## 第五章 风险分析

### 5.1 投资组合流动性风险分析

由于本产品为封闭式产品，故投资组合流动性风险较低，将根据产品的到期时间，做好流动性管理和变现安排。

### 5.2 投资组合投资风险分析

#### 5.2.1 产品债券持仓风险及价格波动情况

截至本报告日，产品持仓债券价格波动处于市场合理区间范围内。

#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

无。

#### 5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

无。

## 第六章 投资账户信息

序号	账户类型	账户编号
1	托管账户	10250000003313118

## 第七章 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。